

自己資本比率の算式における分母の額に関する開示事項
(2023年9月期自己資本比率)

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要 (連結) | | | | | |
|----------------------|--|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 国際様式の 該当番号 (注) | | イ | ロ | ハ | ニ |
| | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
| | | 当四半期末 (2023年9月期) | 前四半期末 (2023年6月期) | 当四半期末 (2023年9月期) | 前四半期末 (2023年6月期) |
| 1 | 信用リスク | 3,159,534 | 3,240,761 | 265,555 | 272,424 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 437,171 | 440,579 | 34,973 | 35,246 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 2,665,188 | 2,742,476 | 226,008 | 232,561 |
| | うち、重要な出資のエクスポージャー | — | — | — | — |
| | うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー | 3,692 | 3,710 | 295 | 296 |
| | その他 | 53,481 | 53,994 | 4,278 | 4,319 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 53,227 | 58,870 | 4,407 | 4,878 |
| 5 | うち、SA-CCR適用分 | 8,576 | 9,674 | 725 | 818 |
| | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、CVAリスク | 18,888 | 20,564 | 1,511 | 1,645 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 1,347 | 1,234 | 107 | 98 |
| | その他 | 24,415 | 27,397 | 2,063 | 2,315 |
| 7 | マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー | 327,783 | 300,843 | 27,796 | 25,511 |
| 8 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式) | 155,154 | 149,778 | 12,412 | 11,982 |
| 9 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式) | 106,428 | 4,783 | 8,514 | 382 |
| | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%) | 19,698 | 38,551 | 1,670 | 3,269 |
| | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%) | 22,859 | 39,520 | 1,938 | 3,351 |
| 10 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%) | 760,713 | 948,146 | 60,857 | 75,851 |
| 11 | 未決済取引 | — | — | — | — |
| 12 | 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー | 37,076 | 36,902 | 2,966 | 2,952 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | — | — | — | — |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 37,076 | 36,902 | 2,966 | 2,952 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分 | — | — | — | — |
| 16 | マーケット・リスク | — | — | — | — |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | — | — | — | — |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | — | — | — | — |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 208,524 | 183,496 | 16,681 | 14,679 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 208,524 | 183,496 | 16,681 | 14,679 |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | — | — | — | — |
| 22 | うち、先進的計測手法適用分 | — | — | — | — |
| 23 | 特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー | 560 | 560 | 47 | 47 |
| | 経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額 | — | — | — | — |
| 24 | フロア調整 | — | — | — | — |
| 25 | 合計 | 4,851,560 | 5,002,215 | 402,847 | 415,331 |

(注)「国際様式の該当番号」とは、パーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。

(平成26年金融庁告示第7号、別紙様式第八号第一面)

(単位:百万円)

| OV1:リスク・アセットの概要 (単体) | | イ | ロ | ハ | ニ |
|----------------------|--|---------------------|---------------------|---------------------|---------------------|
| 国際様式の 該当番号 (注) | | リスク・アセット | | 所要自己資本 | |
| | | 当四半期末 (2023年9月期) | 前四半期末 (2023年6月期) | 当四半期末 (2023年9月期) | 前四半期末 (2023年6月期) |
| 1 | 信用リスク | 2,654,998 | 2,727,291 | 224,945 | 231,091 |
| 2 | うち、標準的手法適用分 | 5,442 | 6,659 | 435 | 532 |
| 3 | うち、内部格付手法適用分 | 2,613,763 | 2,689,102 | 221,647 | 228,035 |
| | うち、重要な出資のエクスポージャー | — | — | — | — |
| | うち、リース取引における見積残存価額のエクスポージャー | — | — | — | — |
| | その他 | 35,792 | 31,530 | 2,863 | 2,522 |
| 4 | カウンターパーティ信用リスク | 49,924 | 54,870 | 4,143 | 4,558 |
| 5 | うち、SA-CCR適用分 | 8,237 | 9,255 | 698 | 784 |
| | うち、カレント・エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| 6 | うち、期待エクスポージャー方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、CVAリスク | 17,414 | 18,531 | 1,393 | 1,482 |
| | うち、中央清算機関関連エクスポージャー | 1,347 | 1,234 | 107 | 98 |
| | その他 | 22,925 | 25,849 | 1,944 | 2,192 |
| 7 | マーケット・ベース方式に基づく株式等エクスポージャー | 323,595 | 298,150 | 27,440 | 25,283 |
| 8 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (ルック・スルー方式) | 222,807 | 216,424 | 17,824 | 17,313 |
| 9 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (マンドート方式) | 106,428 | 4,783 | 8,514 | 382 |
| | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式250%) | 19,633 | 38,487 | 1,664 | 3,263 |
| | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (蓋然性方式400%) | 22,855 | 39,511 | 1,938 | 3,350 |
| 10 | リスク・ウェイトのみなし計算又は信用リスク・アセットのみなし計算 (フォールバック方式1250%) | 758,552 | 946,220 | 60,684 | 75,697 |
| 11 | 未決済取引 | — | — | — | — |
| 12 | 信用リスク・アセットの額の算出対象となっている証券化エクスポージャー | 37,076 | 36,902 | 2,966 | 2,952 |
| 13 | うち、内部格付手法準拠方式又は内部評価方式適用分 | — | — | — | — |
| 14 | うち、外部格付準拠方式適用分 | 37,076 | 36,902 | 2,966 | 2,952 |
| 15 | うち、標準的手法準拠方式適用分 | — | — | — | — |
| | うち、1250%のリスク・ウェイト適用分 | — | — | — | — |
| 16 | マーケット・リスク | — | — | — | — |
| 17 | うち、標準的方式適用分 | — | — | — | — |
| 18 | うち、内部モデル方式適用分 | — | — | — | — |
| 19 | オペレーショナル・リスク | 156,274 | 155,209 | 12,501 | 12,416 |
| 20 | うち、基礎的手法適用分 | 156,274 | 155,209 | 12,501 | 12,416 |
| 21 | うち、粗利益配分手法適用分 | — | — | — | — |
| 22 | うち、先進的計測手法適用分 | — | — | — | — |
| 23 | 特定項目のうち、調整項目に算入されない部分に係るエクスポージャー | — | — | — | — |
| | 経過措置によりリスク・アセットの額に算入されるものの額 | — | — | — | — |
| 24 | フロア調整 | — | — | — | — |
| 25 | 合計 | 4,352,146 | 4,517,851 | 362,624 | 376,309 |

(注)「国際様式の該当番号」とは、バーゼル銀行監督委員会により2015年1月に公表された「開示要件(第3の柱)の改訂」と題する最終規則文書における開示様式に記載された項目番号です。